浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金招募说明书摘要（更新）

2012年第1号

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

内容截止日：2012年11月14日

重要提示

基金募集申请核准文件名称：《关于核准浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2011〕2033号）

核准日期：2011年12月16日

成立日期：2012年5月14日

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，基金管理人保证本摘要的内容真实、准确、完整，本摘要经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本次更新的基金招募说明书已经本基金托管人复核。本基金招募说明书所载内容截止日为2012年11月14日，有关财务数据和净值表现截止日2012年9月30日（财务数据未经审计）

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：浦银安盛基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区浦东大道981号3幢316室

办公地址：上海市卢湾区淮海中路381号中环广场38楼

邮政编码：200020

法定代表人：姜明生

成立时间：2007年8月5日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字〔2007〕207号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.4亿元

存续期间：持续经营

股权结构：上海浦东发展银行（以下简称“浦发银行”）持有51%的股权；法国安盛投资管理有限公司（以下简称“安盛投资”）持有39%的股权；上海盛融投资有限公司（以下简称“上海盛融”）持有10%的股权。

电话：021-23212888

传真：021-23212800

客服电话：400-8828-999；021-33079999

网址：www.py-axa.com

联系人：徐莹

（二）主要人员情况

1、董事会成员

姜明生先生，董事长，本科学历。历任中国工商银行总行信托投资公司业务一部副总经理；招商银行总行信托投资部副总经理；招商银行北京分行行长助理；招商银行广州分行副行长（主持工作）；招商银行总行公司银行部总经理；招商银行上海分行党委书记、副行长（主持工作）；招商银行上海分行党委书记、行长。2007年4月加入上海浦东发展银行，任总行党委委员。2007年9月起任上海浦东发展银行总行副行长，2007年10月至今兼上海浦东发展银行上海分行党委书记、行长。自2009年11月起兼任本公司董事长。

Bruno Guillaton先生，副董事长，法国国籍，毕业于国立巴黎工艺技术学院。于1999年加盟安盛投资管理（巴黎）公司，担任股票部门主管。2000年至2002年，担任安盛投资管理（东京）公司首席执行官。2002年，任职安盛罗森堡公司和安盛投资管理公司的亚洲区域董事。2005年起，担任安盛投资管理公司内部审计全球主管。现任安盛投资管理公司亚洲股东代表。自2009年3月起兼任本公司副董事长。

林道峰先生，董事，工商管理硕士，高级会计师。1985年8月参加工作，1994年3月调入上海浦东发展银行，任杭州分行计划信贷部负责人，2000年3月起任上海浦东发展银行杭州分行行长助理、副行长。2008年3月至今担任上海浦东发展银行个人银行总部副总经理。自2012年3月起兼任本公司董事。

刘长江先生，董事。1998年至2003年担任中国工商银行总行基金托管部副处长、处长，2003年至2005年担任上海浦东发展银行总行基金托管部总经理，2005年至2008年担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部资产托管部总经理、期货结算部总经理，2008年至今担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部副总经理兼资产托管部总经理。自2011年3月起兼任本公司董事。

章曦先生，董事，经济学博士，高级经济师。2009年12月起至今担任上海国盛（集团）有限公司财务总监，2006年3月起至今担任上海建筑材料（集团）总公司副总裁。此前，章曦先生曾历任上海张江集成电路产业区开发有限公司总经理，上海张江高科技园区开发股份有限公司审计法务室主任、董事会秘书、副总经理、财务总监。自2010年1月起兼任本公司董事。

廖正旭先生，董事，斯坦福大学理学硕士和纽约科技大学理学硕士。现任安盛罗森堡投资管理有限公司亚太地区高级研究主任。自2012年3月起兼任本公司董事。

王家祥女士，独立董事。1980年至1985年担任上海侨办华建公司投资项目部项目经理，1985年至1989年担任上海外办国际交流服务有限公司综合部副经理，1989年至1991年担任上海国际信托投资有限公司建设部副经理，1991年至2000年担任汇信银行有限公司（原汇天财务有限公司）总裁助理，2000年至2002年担任上海实业药业有限公司总经理助理，2002年至2006年担任上海实业集团有限公司顾问。自2011年3月起担任本公司独立董事。

尹应凯（Richard Yin）先生，独立董事，澳大利亚国籍，英格兰及威尔士特许会计师协会和澳大利亚特许会计师协会的资深会员，有十年以上在各类监管机构任职的经历，现任First Yangtze Group Ltd集团主席。自2007年8月起兼任本公司独立董事。

谢百三先生，独立董事。北京大学经济系硕士研究生毕业，1988年起担任清华大学经济管理学院副教授，1990年起担任复旦大学管理学院教授、博士生导师，现同时担任复旦大学金融与资本市场研究中心主任。自2012年7月起兼任本公司独立董事。

2、监事会成员

黄跃民先生，监事长，华东师范大学国际关系专业硕士研究生，现任上海盛融投资有限公司总裁。自2007年8月起兼任本公司监事长。

James Young先生，监事，本科学位，新西兰国籍。2006年1月起担任AXA Rosenberg亚太地区首席运营官，自2012年3月起兼任本公司监事。

陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001年7月至2003年6月，任国泰君安证券有限公司研究所金融工程研究员。2003年7月至2007年9月，任银河基金管理有限公司金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月至今，任浦银安盛基金管理有限公司金融工程部总监。2010年12月10日起兼任浦银安盛沪深300增强型指数基金基金经理，2012年5月14日起兼任浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理。自2012年3月起兼任本公司职工监事。

3、公司总经理及其他高级管理人员

郁蓉华女士，复旦大学工商管理硕士，自1994年7月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自2012年7月23日起担任本公司总经理。

李宏宇先生，西南财经大学经济学博士。1997年起曾先后就职于中国银行、道勤集团和上海东新国际投资管理有限公司分别从事联行结算、产品开发以及基金研究和投资工作。2007年3月起加盟本公司，历任公司产品开发部总监、市场营销部总监、首席市场营销官。自2012年5月2日起，担任本公司副总经理兼首席市场营销官。

喻庆先生，中国政法大学经济法专业硕士和法务会计专业研究生学历，中国人民大学应用金融学硕士研究生学历。历任申银万国证券有限公司国际业务总部高级经理；光大证券有限公司（上海）投资银行部副总经理；光大保德信基金管理有限公司副督察长、兼事会秘书和监察稽核总监。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001年7月至2003年6月，任国泰君安证券有限公司研究所金融工程研究员。2003年7月至2007年9月，任银河基金管理有限公司金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月至今，任浦银安盛基金管理有限公司金融工程部总监。2010年12月起兼任浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。本公司职工监事。具有11年证券从业经历。

5、投资决策委员会成员

郁蓉华女士，本公司总经理，并任投资决策委员会主席。

李宏宇先生，本公司副总经理兼首席市场营销官。

黄列先生，本公司研究部总监。

陈士俊先生，本公司金融工程部总监，浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金以及浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理并兼任本公司职工监事。

吴勇先生，本公司权益投资部总监，公司旗下浦银安盛红利股票基金及浦银安盛精致生活混合基金基金经理。

蒋建伟先生，本公司旗下浦银安盛价值成长股票基金及浦银安盛优化价值债券基金基金经理。

薛钟先生，本公司固定收益投资部总监，公司旗下浦银安盛货币市场基金、浦银安盛增利分级债券基金和浦银安盛幸福回报债券基金基金经理。

顾佳女士，本公司合规风控部总经理。

督察长、其他基金经理及基金经理助理列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：中国邮政储蓄银行）

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：450亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可〔2009〕673号

联系人：王瑛

联系电话：010-68858126

（二）主要人员情况

徐进，托管业务部总经理，14年金融从业经历，曾就职于中国邮政储蓄银行汇兑业务部、代理业务部，具有丰富的金融业务管理经验。

（三）托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心，以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2012年9月30日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共16只，包括中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）（166006）、长信中短债证券投资基金（519985）、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利分级债券型证券投资基金（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）、天弘丰利分级债券型证券投资基金（164208）、鹏华丰泽分级债券型证券投资基金（160618）、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（400015）、长安宏观策略股票型证券投资基金（740001）、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金（162105）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金（166012）、农银汇理消费主题股票型证券投资基金（660012）、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金（519117）、天弘现金管家货币市场基金（420006）、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036（A类）、040037（B类））。托管的特定客户资产管理计划共12只，其中9只已到期，包括南方-灵活配置之出口复苏1号资产管理计划、景顺长城基金-邮储银行-稳健配置型特定多个客户资产管理计划、银华灵活精选资产管理计划、长盛灵活配置资产管理计划、富国基金-邮储银行-绝对回报策略混合型资产管理计划、光大保德信-邮储银行-灵活配置1号资产管理计划、大成-邮储银行-灵活配置1号特定多个客户资产管理计划、银华灵活配置资产管理计划、长盛-邮储-灵活配置2号资产管理计划、南方灵活配置2号资产管理计划、鹏华基金鹏诚理财高息债分级2号资产管理计划等。至今中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司定向资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达1,399.68亿元。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）浦银安盛基金管理有限公司上海直销中心

地址：中国上海市淮海中路381号中环广场38楼

电话：021-23212899

传真：021-23212890

客服电话：400-8828-999；021-33079999

联系人：徐莹

网址：www.py-axa.com

（2）电子直销

浦银安盛基金管理有限公司电子直销

交易网站：www.py-axa.com

客服电话：400-8828-999；021-33079999

2、场外代销机构

（1）中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

公司网址：www.psbc.com

（2）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

传真：021-63604199

联系人：唐苑

客户服务热线：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（3）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

客户服务热线：95559

公司网址：www.bankcomm.com

（4）招商银行股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：秦晓

客户服务热线：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（5）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：宁黎明

客户服务热线：021-962888

公司网址：www.bankofshanghai.com

（6）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

客服电话：021-962505

公司网址：www.sw2000.com.cn

（7）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：祝幼一

客户服务热线：4008888666

公司网址：www.gtja.com

（8）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：胡关金

客服电话：4008-888-888

公司网站：www.chinastock.com.cn

（9）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号1001A、1001B室

法定代表人：王开国

客服电话：400-8888-001、021-95553

公司网址：www.htsec.com

（10）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

客服电话：400-888-8788

公司网址：www.ebscn.com

（11）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

法定代表人：王志伟

客服电话：95575

公司网站：www.gf.com.cn

（12）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：张佑君

咨询电话：4008-888-108

公司网站：www.csc108.com

（13）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人：张志刚

客户服务热线：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

（14）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人：黄金琳

客户服务热线：0591-96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

（15）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

法定代表人：林义相

客户服务热线：010-66045678

天相投顾网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.txjijin.com

（16）齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经十路20518号

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（17）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦

法定代表人：王东明

客户服务热线：400-666-5589

公司网址：www.cs.ecitic.com

（18）中信万通证券有限责任公司

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层

法定代表人：张智河

客服电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（19）中信证券（浙江）有限责任公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

客服电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

（20）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

（21）中航证券有限公司

住所：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：杜航

客服电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（22）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（23）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

客户服务热线：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

（24）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

客服电话：96528或962528

公司网址：www.nbcb.com.cn

（25）上海证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人：祝幼一

客户服务热线：4008-918-918、021-962518

网址：www.962518.com

（26）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客服电话：95597

公司网站：www.htsc.com.cn

（27）德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市浦东新区福山路500号26楼

法定代表人：姚文平

客户服务电话：4008888128

网址：www.tebon.com.cn

（28）万联证券有限责任公司

地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

法定代表人：张建军

客服电话：400-888-8133

网址：www.wlzq.com.cn

（29）杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

（30）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：4000-891-289

网址：www.erichfund.com

（31）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

3、场内代销机构

名单详见基金份额发售公告。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《基金合同》等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行信息披露义务。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海市君悦律师事务所

办公地址：上海市天山路600弄1号同达创业大厦22楼

负责人：刘正东

电话：021-61132988

传真：021-61132913

联系人：王伟斌

经办律师：李健、王伟斌

（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16层

办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

法定代表人：葛明

电话：021-24052000

传真：021-54075507

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金采取指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的有效跟踪。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过0.35%，且年化跟踪误差不超过4%，以实现对业绩比较基准的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

其中，股票资产占基金资产净值的比例为90%-95%，投资于中证锐联基本面400指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如以后法律法规及监管机构允许基金投资其他品种，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采取完全复制方法进行指数化投资，依据中证锐联基本面400指数成份股及其权重配比，合理设置个股投资权重，构建股票组合，使股票组合能有效跟踪中证锐联基本面400指数的表现，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过0.35%，且年化跟踪误差不超过4%。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其它原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为6个月，6个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

（一）资产配置

本基金追求对股票的充分投资。本基金股票资产占基金资产净值的比例为90%-95%，其中中证锐联基本面400指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。

（二）组合构建

本基金原则上将采用完全复制的方式，基金资产将按照标的指数的成份股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。

（三）股票组合调整方法

在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人将对投资组合进行调整，以降低跟踪误差，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

1、指数编制方法发生变更

本基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响，相应调整投资组合。

2、指数成份股定期或临时调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

3、指数成份股出现退市或重大事件（增发、配股、派发现金股息等）情形

本基金管理人将密切关注样本股票权重变化以及对指数的影响，进行相应的调整。

4、基金发生申购赎回的情况

本基金管理人根据申购赎回的情况，对投资组合进行调整，从而有效地跟踪标的指数。

5、如果由于法律法规限制，股票流动性不足，股票停牌等因素，部分成份股无法按照指数成份股及其权重配置进行投资，本基金管理人将根据市场情况，以跟踪误差最小化为原则，决定部分持有现金或投资其他股票进行替代。如果采取其他股票替代方式，本基金在综合考虑拟用于替代的股票与被替代股票的行业属性、基本面情况、股价相关性等多个方面的基础上，选取特征较为相近的股票进行替代。

6、本基金管理人将根据新股申购的预期收益，可适量参与一级市场新股认购，适当提高基金资产的投资收益。

（四）期货投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，在债券投资部分将重点投资到期日在一年以内的国债、金融债等债券，目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

（五）其他金融工具投资策略

在法律法规允许时，本基金可基于谨慎原则运用股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，提高投资效率，管理基金投资组合风险，以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不应用于投机交易目的，或用作杆杠工具放大基金的投资。

九、业绩比较基准

本基金股票资产的标的指数为中证锐联基本面400指数。

本基金业绩比较基准：

中证锐联基本面400指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

中证锐联基本面400指数是中证指数有限公司开发的反映中国A股市场基本面价值的系列指数之一，该指数系列以沪深A股为样本空间，分别挑选基本面价值指标位于中间的第201至第600家的400家上市公司作为样本。基本面价值由四个财务指标来衡量：营业收入、现金流、净资产和分红，样本股的权重配置由基本面价值决定，在一定程度上打破了样本市值与其权重之间的关联，避免了传统市值指数中过多配置高估股票的现象。该指数是中证指数有限公司在基本面指数理念方面的进一步实践和扩展。

如果中证锐联基本面400指数被停止编制及发布，或中证锐联基本面400指数由其它指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致中证锐联基本面400指数不宜继续作为标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则在履行适当程序后变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数和业绩比较基准。本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，不需召开基金份额持有人大会通过，但应经基金托管人同意并报中国证监会核准，并在中国证监会指定的至少一家媒体上公告。

十、风险收益特征

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人——中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2012年9月30日。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	227,728,394.12	93.35
	其中：股票	227,728,394.12	93.35
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	15,954,641.26	6.54
6	其他各项资产	266,261.58	0.11
7	合计	243,949,296.96	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,902,507.38	0.78
B	采掘业	6,488,466.72	2.67
C	制造业	124,568,764.02	51.35
C0	食品、饮料	7,488,714.81	3.09
C1	纺织、服装、皮毛	4,341,083.46	1.79
C2	木材、家具	858,136.20	0.35
C3	造纸、印刷	4,245,391.18	1.75
C4	石油、化学、塑胶、塑料	24,490,226.52	10.10
C5	电子	6,354,323.42	2.62
C6	金属、非金属	23,031,451.85	9.49
C7	机械、设备、仪表	32,869,064.29	13.55
C8	医药、生物制品	18,139,906.75	7.48
C99	其他制造业	2,750,465.54	1.13
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,077,401.48	3.33
E	建筑业	5,289,190.21	2.18
F	交通运输、仓储业	7,602,535.80	3.13
G	信息技术业	8,786,465.51	3.62
H	批发和零售贸易	21,091,498.54	8.70
I	金融、保险业	4,358,393.58	1.80
J	房地产业	18,394,137.35	7.58
K	社会服务业	4,676,485.44	1.93
L	传播与文化产业	3,349,749.07	1.38
M	综合类	13,142,799.02	5.42
	合计	227,728,394.12	93.88

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600881	亚泰集团	435,917	2,101,119.94	0.87
2	600596	新安股份	217,678	1,928,627.08	0.80
3	000422	湖北宜化	155,379	1,886,301.06	0.78
4	000012	南玻A	247,800	1,756,902.00	0.72
5	600210	紫江企业	461,633	1,555,703.21	0.64
6	000623	吉林敖东	100,892	1,522,460.28	0.63
7	600655	豫园商城	185,517	1,511,963.55	0.62
8	000717	韶钢松山	704,575	1,472,561.75	0.61
9	601377	兴业证券	150,642	1,447,669.62	0.60
10	600820	隧道股份	171,900	1,380,357.00	0.57

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	11,175.52
4	应收利息	2,912.16
5	应收申购款	2,173.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	266,261.58

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

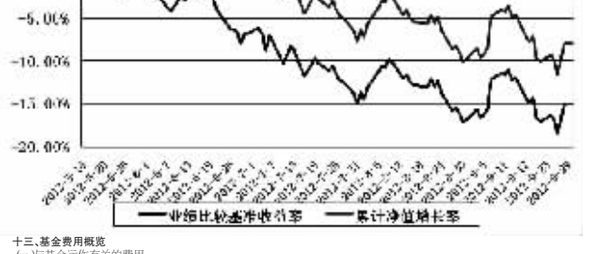
（一）基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	净值增长率值①	净值增长率标准差率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012/5/14-2012/9/30	-7.90%	1.07%	-15.01%	1.30%	7.11%	-0.23%

（二）自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2012年5月14日至2012年9月30日



十三、基金费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）基金合同生效后的指数许可使用费；

（4）基金合同生效后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

（7）基金的证券交易费用；

（8）基金财产投划支付的银行费用；

（9）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为1.0%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.15%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

（3）基金合同生效后的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。

基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值及指数许可使用费年费率每日计提，逐日累计。计算方法如下：

H=E×Li÷当年天数

H为每日应计提的指数许可使用费；

E为前一日的基金资产净值；

Li为指数许可使用费年费率。

在基金成立之后的前两年（即基金合同生效日起至第二个周年日止），指数许可使用费按前一日的基金资产净值的万分之九的年费率计提。从基金成立的第三年起，如果前一日的基金资产规模净值超过或等于40亿元，计费当日的指数许可使用费按照万分之九的年费率计提；如果不足40亿元，则计费当日的指数许可使用费按照万分之十二的年费率计提。

每季度指数许可使用费下限为人民币壹拾伍万元（15万元）。基金合同生效后的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次，于每年1月、4月、7月、10月的前十个工作日前从基金财产中一次性支付。基金成立当年，不足3个月的，按照3个月收费。

由于中证指数有限公司保留变更或提高指数许可使用费的权利，如果指数许可使用费的计算方法、费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在至少一家指定媒体进行公告。

（4）上述“一”中4到8项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金业收取认购费的，可以从认购费中列支。

5、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、本基金的申购费用由申购本基金的投资人承担，